

Державний вищий навчальний заклад
«Донецький національний технічний університет»
Кафедра управління і фінансово-економічної безпеки

«ЗАТВЕРДЖУЮ»

Перший проректор

_____ Леонід БАЧУРІН

« _____ » _____ 2023 р.

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

ОНД 2.13 РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТ

(шифр і назва навчальної дисципліни)

Рівень освіти: перший (бакалаврський)

Спеціальність 073 Менеджмент

(шифр і назва спеціальності)

Освітня програма Менеджмент

Мова навчання: українська

Робоча програма навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент» для здобувачів вищої освіти за спеціальністю 073 Менеджмент.

«_____» _____ 2023 року. – 7 с.

Розробники: В.М. Антоненко, к.е.н., доцент, доцент кафедри управління і фінансово-економічної безпеки

Робоча програма затверджена на засіданні кафедри управління і фінансово-економічної безпеки
(назва кафедри)

Протокол № 5 від “28” 12 2023_р.

Завідувачка кафедрою управління і фінансово-економічної безпеки

_____ (Ольга ПОПОВА)
(підпис) (прізвище та ініціали)

“28” 12 2023_р.

Схвалено науково-методичною комісією 07 Управління та адміністрування
(шифр, назва)

Протокол № ____ від. “ ____ ” _____ 20__ р.

“ ____ ” _____ 20__ р. Голова _____ (Ярослав ЛЯШОК)
(підпис) (прізвище та ініціали)

1. Загальна інформація

| | | |
|---|---|-----------|
| Форма навчання | Денна | Заочна |
| Статус | обов'язкова | |
| Обсяг в кредитах ЄКТС | 6 | 6 |
| Обсяг в годинах за навчальним планом, разом: в тому числі: | 180 | 180 |
| лекції: | 48 годин | 6 годин |
| практичні заняття: | 32 години | 6 годин |
| лабораторні заняття: | - | |
| семінари: | - | |
| самостійна робота: | 100 годин | 168 годин |
| Форма підсумкового контролю | Екзамен / диф. залік | |
| Дисципліну викладають | Викладач: Антоненко Валентина Миколаївна https://donntu.edu.ua/fem/ufeb valentina.antonenko@donntu.edu.ua | |

Передумови для вивчення дисципліни:

перелік дисциплін, які мають бути вивчені раніше:

Вища математика, теорія ймовірностей та математична статистика, економетрія, менеджмент, фінанси, стратегічний менеджмент.

2. Мета вивчення навчальної дисципліни

Мета навчальної дисципліни: формування у студентів знань основних положень теорії і практики ризик-менеджменту в сфері функціональної діяльності суб'єктів господарювання, вироблення навичок прийняття рішень з проблем виявлення, ідентифікації та мінімізації ризиків.

Компетентності:

загальні: здатність до абстрактного мислення, аналізу, синтезу; знання та розуміння предметної області і професійної діяльності; навички використання інформаційних і комунікаційних технологій; здатність вчитися і оволодівати сучасними знаннями; здатність до адаптації і дії в новій ситуації та генерування нових ідей;

фахові: здатність визначати перспективи розвитку організації з урахуванням сучасних ризиків у підприємницькій діяльності; здатність управляти організацією та її підрозділами через реалізацію функцій менеджменту; здатність планувати діяльність організації в умовах дії зовнішніх і внутрішніх загроз; здатність оцінювати виконувані роботи; здатність створювати та організовувати ефективні комунікації в процесі управління ризиками.

3. Очікувані результати навчання

Формуються у відповідності до поставленої мети навчальної дисципліни.

Очікувані результати навчання полягають у тому, що в процесі викладання дисципліни студенти навчаються: застосовувати набуті теоретичні знання для розв'язання практичних завдань та змістовно інтерпретувати отримані результати; демонструвати знання теорій, методів і функцій ризик-менеджменту, навички виявлення проблем та обґрунтування управлінських рішень; застосовувати методи ризик-менеджменту для забезпечення ефективної діяльності організації; демонструвати навички аналізу ризикових ситуацій та здійснення відповідних управлінських заходів.

4. Засоби діагностики результатів навчання

Засобами оцінювання та методами демонстрування результатів навчання є:

- екзамен;
- стандартизовані тести;
- доповіді на практичних заняттях;
- презентації результатів виконаних завдань та досліджень;

- виступи на наукових заходах (семінарах та конференціях);
- інші види індивідуальних та групових завдань.

Поточний контроль здійснюється під час проведення практичних занять і має на меті як перевірку рівня підготовленості студента до виконання конкретної роботи, так і оцінювання виконання відповідних робіт. Форма проведення поточного контролю під час навчальних занять і система оцінювання рівня знань студентів визначаються відповідно до розподілу балів за темами навчальної дисципліни.

Підсумковий контроль проводиться як семестровий при проведенні іспиту з навчальної дисципліни.

5. Критерії оцінювання результатів навчання

Критерії оцінювання формують порядок оцінювання під час поточного контролю (за результатами практичних занять та виконання індивідуальних або групових завдань) та підсумкового контролю.

| Поточний контроль (в чисельнику – максимальний бал при правильному і своєчасному виконанні завдання; в знаменнику – мінімальний бал при правильному, але несвоєчасному виконанні завдання) | | | | | | | | | | | | | | | | Максимальний / мінімальний бал за результатами: | | |
|--|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---|--------|--------|
| Пр. 1 | Пр. 2 | Пр. 3 | Пр. 4 | Пр. 5 | Пр. 6 | Пр. 7 | Пр. 8 | Пр. 9 | Пр. 10 | Пр. 11 | Пр. 12 | Пр. 13 | Пр. 14 | Пр. 15 | Пр. 16 | поточного контролю | іспиту | всього |
| денна форма | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 3 | 3 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 2 | 3 | 3 | 4 | 4 | 40 | 60 | 100 |
| 2 | 2 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 2 | 2 | 3 | 3 | 24 | 60 | 84 |
| заочна форма | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 12 | 14 | 14 | | | | | | | | | | | | | | 40 | 60 | 100 |
| 6 | 9 | 9 | | | | | | | | | | | | | | 24 | 60 | 84 |

Для оцінювання курсових робіт застосовується наступна шкала:

| Пояснювальна записка | Графічна частина | Захист роботи | Максимальний бал |
|----------------------|------------------|---------------|------------------|
| до 20 | до 20 | 60 | 100 |

Результати підсумкового контролю оцінюються за 100-бальною шкалою та чотирибальною («відмінно», «добре», «задовільно», «незадовільно»).

Відповідність між шкалами встановлюється наступним чином:

| Оцінка / курсова робота | |
|-------------------------|--------------------------------|
| За 100-бальною шкалою | Для екзамену / курсової роботи |
| 90-100 | відмінно |
| 74-89 | добре |
| 60-73 | задовільно |
| 0-59 | незадовільно |

6. Програма навчальної дисципліни

6.1. Основні теми дисципліни

- Тема 1. Ризик як об'єкт управління.
Тема 2. Основні концепції ризик-менеджменту підприємств.
Тема 3. Методичні засади аналізу ризиків підприємства.
Тема 4. Кількісні методи аналізу та оцінки ризиків.
Тема 5. Експертні методи аналізу та оцінки ризиків.
Тема 6. Застосування теорії ігор для оцінки ризиків.
Тема 7. Моделювання та аналіз ризиків інвестиційних проєктів.
Тема 8. Підходи та методи управління ризиками підприємства.
Тема 9. Стандарти організації ризик-менеджменту підприємств.

6.2. Темати практичних занять

| № з/п | Назва теми | Кількість годин | |
|-------|--|-----------------|--------|
| | | Д.ф.н. | З.ф.н. |
| 1 | Тема 1. Ризик як об'єкт управління. | 3 | 2 |
| 2 | Тема 2. Основні концепції ризик-менеджменту підприємств. | 4 | |
| 3 | Тема 3. Методичні засади аналізу ризиків підприємства. | 3 | 2 |

| | | | |
|---------------------|---|-----------|----------|
| 4 | Тема 4. Кількісні методи аналізу та оцінки ризиків. | 4 | |
| 5 | Тема 5. Експертні методи аналізу та оцінки ризиків. | 4 | 1 |
| 6 | Тема 6. Застосування теорії ігор для оцінки ризиків. | 3 | |
| 7 | Тема 7. Моделювання та аналіз ризиків інвестиційних проєктів. | 4 | |
| 8 | Тема 8. Підходи та методи управління ризиками підприємства. | 4 | 1 |
| 9 | Тема 9. Стандарти організації ризик-менеджменту підприємств. | 3 | |
| Усього годин | | 32 | 6 |

6.3. Теми лабораторних занять

Лабораторні заняття не передбачені навчальним планом.

6.4. Самостійна робота

| № з/п | Назва теми | Кількість годин | |
|---------------------|---|-----------------|------------|
| | | Д.ф.н. | З.ф.н. |
| 1 | Тема 1. Ризик як об'єкт управління. | 6 | 12 |
| 2 | Тема 2. Основні концепції ризик-менеджменту підприємств. | 10 | 20 |
| 3 | Тема 3. Методичні засади аналізу ризиків підприємства. | 6 | 12 |
| 4 | Тема 4. Кількісні методи аналізу та оцінки ризиків. | 10 | 20 |
| 5 | Тема 5. Експертні методи аналізу та оцінки ризиків. | 6 | 12 |
| 6 | Тема 6. Застосування теорії ігор для оцінки ризиків. | 6 | 10 |
| 7 | Тема 7. Моделювання та аналіз ризиків інвестиційних проєктів. | 10 | 20 |
| 8 | Тема 8. Підходи та методи управління ризиками підприємства. | 10 | 20 |
| 9 | Тема 9. Стандарти організації ризик-менеджменту підприємств. | 6 | 12 |
| 10 | Виконання курсової роботи | 30 | 30 |
| Усього годин | | 100 | 168 |

6.5. Індивідуальні та/або групові завдання

Основна мета виконання студентами індивідуальних робіт – закріпити знання, отримані ними під час лекційних і практичних занять, поглиблено дослідити окремі тематичні питання навчальної дисципліни.

До індивідуальних завдань відносяться: підготовка доповідей, підготовка тез до виступу на конференціях, участь в конкурсах наукових робіт тощо.

Тематика курсових робіт:

1. Сутність, методи і призначення якісного і кількісного аналізу ризику.
2. Сутність, сфера застосування, переваги і недоліки аналізу беззбитковості.
3. Сутність і призначення методу Монте-Карло.
4. Ідентифікація ризиків: сутність, призначення, особливості проведення.
5. Комплексна система управління ризиками: особливості, мета, завдання, основні етапи.
6. Метод коригування ставки дисконту як метод урахування інвестиційного ризику: сутність, призначення, переваги, недоліки.
7. Застосування експертного аналізу ризиків для оцінки ступеня ризику країни: методика Швейцарської банківської корпорації і методика фірми BERI.
8. Особливості оцінки та управління виробничими ризиками.
9. Особливості оцінки та управління фінансовими ризиками.
10. Особливості оцінки та управління інноваційними ризиками.
11. Особливості оцінки та управління банківськими та валютними ризиками.
12. Особливості оцінки та управління кредитними та відсотковими ризиками.
13. Особливості оцінки та управління інфляційними ризиками.
14. Особливості оцінки та управління маркетинговими ризиками.
15. Особливості оцінки та управління ризиками цінних паперів.
16. Особливості оцінки та управління майновими ризиками.
17. Порівняльна оцінка ефективності страхування та самострахування (методика Хаустона): сутність, механізм застосування, переваги та недоліки.

18. Ф'ючерси, форварди та угоди з опціонами як способи впливу на ризик: сутність, переваги, недоліки, сфера застосування.
19. Особливості урахування ризику країни. Якісні та кількісні методики оцінки ризику країни.

Тема курсової роботи обирається студентом самостійно, з огляду на його професійний інтерес та можливості пошуку відповідних інформаційних джерел.

7. Література

7.1. Основна

1. Калініченко З.Д. Ризик-менеджмент: навчальний посібник для здобувачів спец. 051 «Економіка» та 073 «Менеджмент». Дніпро : ДДУВС, 2021. 224 с. Режим доступу: <https://er.dduvs.in.ua/bitstream/123456789/5854/1/1%20Калініченко%203%20РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТ%20Навч%20посіб.pdf>.
2. Мороз В.М. Ризик-менеджмент : навч. посіб. для студ. спец. 281 «Публічне управління та адміністрування» / В.М. Мороз, С.А. Мороз. Київ : Видавничий дім «Кондор», 2019. 140 с.
3. Плани практичних занять і завдання для самостійної роботи з навчальної дисципліни «Ризик менеджмент» для студентів другого (магістерського) рівня вищої освіти галузі знань 07 «Управління та адміністрування» спец. 073 «Менеджмент» спеціалізації «Бізнес-адміністрування» заочної форми навчання (вибіркова) / уклад. Л.В. Нечипорук. Харків : Нац. юрид. ун-т ім. Ярослава Мудрого, 2019. 38 с.
4. Ріщук Л.І. Управління ризиками : конспект лекцій. Івано-Франківськ : ІФНТУНГ. 2020. 68 с.
5. Старостіна А.О. Ризик-менеджмент. Київ : Кондор, 2018. 220 с.
6. Управління ризиками : Навчальний наочний посібник : навч. посіб. для студ. спец. 073 «Менеджмент» / М.О. Кравченко, К.О. Бояринова, К.О. Копішинська; КПІ ім. Ігоря Сікорського. Київ : КПІ ім. Ігоря Сікорського, 2021. 432 с. Режим доступу: https://ela.kpi.ua/bitstream/123456789/43528/1/Upravlinnia-ryzykamy_NavchNaochPosib.pdf.

7.2. Додаткова

1. Балусєва О.В., Гончаров В.М., Ларіна Р.Р. Управління ризиками в логістиці. Навчальний посібник для ВНЗ. Київ : Кондор. 2019. 254 с.
2. Кармінська-Белоброва Є.М., Ігнатова М.В. Управління ризиками у підприємстві : навчальний посібник. Харків : «Слово», 2014. 169 с.
3. Кондрашихін А.Б. Теорія та практика підприємницького ризику. Навчальний посібник. Київ : Центр навчальної літератури, 2016. 224 с.
4. Кучеренко В.Р., Карпов В.А., Карпов А.В. Економічний ризик та методи його вимірювання : Навчальний посібник. Одеса, 2011. 199 с.
5. Методичні вказівки до практичних занять з навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент у сфері фінансових послуг» для студентів спеціальності 7.030508 «Фінанси і кредит» усіх форм навчання. Суми. Сумський державний університет / укладачі В.М. Олійник, Суми : Сумський державний університет, 2012. 55 с.
6. Мороз В.М., Мороз С.А. Ризик-менеджмент : навч. посібник для студ. спец. 281 «Публічне управління та адміністрування». Харків : НТУ «ХПІ», 2018. 140 с. Режим доступу: [Book_2018_Moroz_Ryzyk_menedzhment.pdf \(kpi.kharkov.ua\)](#).
7. Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків: методичні вказівки до курсової роботи для студентів спеціальності 076 «Підприємництво, торгівля та біржова діяльність» денної та заочної форм навчання / О.М. Полінкевич, О.В. Скорук, І.Г. Волинець. Луцьк : СНУ імені Лесі Українки, 2018. 43 с.
8. Посохов І.М. Управління ризиками у підприємстві : навч. посіб. Харків : НТУ «ХПІ», 2015. 220 с.
9. Ріщук Л.І. Управління ризиками: практикум. Івано-Франківськ : ІФНТУНГ. 2020. 47 с.
10. Ріщук Л.І. Управління ризиками : метод. вказ. для сам. вивчення дисципліни. Івано-Франківськ : ІФНТУНГ, 2017. 42 с.
12. Управління ризиками: Курсова робота : навч. посіб. для здобувачів ступеня бакалавра за освітньою програмою «Менеджмент і бізнес-адміністрування», спец. 073 «Менеджмент» /

7.3. Методична

1. Методичні рекомендації до самостійного вивчення дисципліни (в розробці).
2. Методичні рекомендації до підготовки курсової роботи з навчальної дисципліни «Ризик-менеджмент» для студентів ОС «Бакалавр» всіх форм навчання галузі знань 07 «Управління та адміністрування» / Уклад. : В.М. Антоненко. – Луцьк : ДонНТУ, 2023. – 30с.).
ea.donntu.edu.ua/jspui/handle/123456789/35107
3. Методичні рекомендації до практичних занять з навчальної дисципліни (в розробці).

8. Інформаційні ресурси

1. Інтернет-портал для управлінців: офіційний веб-портал. URL: <http://management.com.ua>.
2. Інтернет портал інституту ризик-менеджменту: офіційний веб-портал. URL: <http://theirm.org/the-risk-profession/risk-management.aspx>.
3. Онлайн-Бібліотека : офіційний веб-портал. URL: <https://www.twirpx.com/files/science/business/risk/?ft=package>.
4. Національна бібліотека України ім. В.І. Вернадського: офіційний веб-портал. URL: <http://nbuv.gov.ua>.